DAILY SIGNAL

平成27年9月8日(火)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 9/8 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは179兆7,000億円。
無担保コールON物は朝方0.075～0.077%で取引され、前場は同水準で推移した。
後場に入り、調整程度の出合いが散見され引けた。
本日入札が実施されたTDB556回債(6M)の最高利回りは▲0.0020%となり、前回債(549回債、6M、最高利回り▲0.0158%)から上昇した。

	即日オペ種類	オファー額	準預残見込	所要対比
8:00	－	－	1,797,000	+1,797,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				9/8 のオペ結果
	9/8(火)		9/9(水)		9/10(木)		9/11(金)		
券	+1,100		+300		▲1,000		▲1,000		9:20 ノーオペ
財政	+1,500		+4,900		▲21,000		+3,000		10:10 ノーオペ
過不足	+2,600		+5,200		▲22,000		+2,000		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	
国債買入		+4,900		+12,100					12:50 ノーオペ
国庫短期証券買入		+6,000							13:00 ノーオペ
国債買現先									
共通担保(本店)									
共通担保(全店)	▲7,200	+9,200					▲5,600		
CP買現先									
CP等買入	▲500	+5,000	▲200						
社債等買入			▲100						
ETF買入		+400		+300					
J－REIT買入									
被災地金融機関支援貸出									
国債補完供給									
成長基盤強化支援貸出増加支援									
当座預金増減	+20,400		+17,300		▲22,000		▲3,600		
当座預金残高	2,346,600		2,363,900		2,341,900		2,338,300		
準備預金残高	2,137,900		共通担保オペ当社予想						共通担保(本店) 0
積み終了先	1,794,400		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(全店) +15,000		共通担保(全店) 67,853
超過準備	1,794,300								国債買現先 0
非準預先残高	208,700								CP買現先 0
準備預金進捗率	99.9%								成長基盤強化 51,360
平均	77.4%		予想込増減	+17,300	予想込増減	▲22,000	予想込増減	+11,400	被災地金融機関支援 3,166
乖離率	22.5%		当預見込	2,363,900	当預見込	2,341,900	当預見込	2,353,300	ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,028,900
9/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 1,500
9/9 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 200

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	0.120	0.050	0.060	0.075
ビッド	0.075	0.010	0.100	0.090
出来値	－	－	－	－

9/7 時点のマネタリーベース(単位:億円) 3,282,800

(参考)日銀B/S(単位:兆円)

	13年末実績	14年末実績	8/31
長期国債	142	202	258
CP等	2.2	2.2	2.3
社債等	3.2	3.2	3.3
ETF	2.5	3.8	6.0
J－REIT	0.14	0.18	0.25
貸出支援基金	9.2	25	29
国庫短期証券	40	49	49
その他とも資産計	224	300	361
銀行券	90	93	91
当座預金	107	178	231
その他とも負債・純資産計	224	300	361

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
9/8	556(6M)	−0.0020%	−0.0080%
9/3	555(3M)	0.0000%	−0.0032%
8/27	554(3M)	−0.0020%	−0.0056%

9/7 のコール市場残高(前日比)

合計	203,635	+3,981
有担	130,527	+678
無担	73,108	+3,303

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	0.030	0.060	－	－	－	－	－	－	－	－	－
最高	0.130	0.130	－	－	－	－	－	－	－	－	－
加重平均	0.075	0.082	0.125	0.130	0.170	－	－	－	－	－	－
東京レポ・レート	0.053	0.076	－	0.055	0.049	0.020	0.018	－	0.035	0.041	0.049

§ 9/9 オファーのオペと市場動向予想

足許金利は引き続き0.07%台後半で取引されるだろう。
共通担保オペは1兆5,000億円のロールを予想する。

9/9 の予定(国内)
8:50 8月のﾏﾈｰｽﾄｯｸ(日銀)
14:00 8月の消費動向調査(内閣府)

9/9 の予定(海外)
米 週間のMBA住宅ﾛｰﾝ申請指数

翌営業日の即日オペ予想					翌営業日の出合いレンジ予想								
即日オペ金額		当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎	ノーオペ	+17,300	2,363,900	+2,363,900	0.055	0.075	0.075	0.080	0.085	0.117	0.118	0.130	0.200
					～	～	～	～	～	～	～	～	～
					0.125	0.120	0.120	0.120	0.140	0.155	0.160	0.170	0.300

共通担保資金供給(全店) *当日物

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/9/8 ～ 2015/12/18	15,000	9,160	9,160	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/9/7 ～ 2015/12/7	8,000	580	580	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/9/4 ～ 2015/12/15	15,000	8,210	8,210	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/9/1 ～ 2015/12/11	15,000	8,450	8,450	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/8/31 ～ 2015/11/30	8,000	1,560	1,560	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/8/28 ～ 2015/12/8	15,000	9,350	9,350	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/8/24 ～ 2015/11/24	8,000	2,691	2,691	0.10%	固定金利	－	札割れ
2015/8/17 ～ 2015/11/16	8,000	1,240	1,240	0.10%	固定金利	－	札割れ

共通担保資金供給(本店) *当日物

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2012/6/5 ～ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2012/6/1 ～ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2012/4/20 ～ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
2012/3/5 ～ 2012/3/26	8,000	13,570	8,003	0.10%	0.100%	59.0%	1.70

米ドル資金供給オペ

期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
9/3 ～ 9/11	担保範囲内	0	0	0.640%	固定金利	－	応札なし
8/27 ～ 9/3	担保範囲内	2	2	0.640%	固定金利	－	1.00

本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。
上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会